

鹏扬泓利债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬泓利债券
基金主代码	006059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 12 日
报告期末基金份额总额	5,801,416,922.29 份
投资目标	本基金在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、可转债/可交换债投资策略、国债期货投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略以及股票投资策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*5%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
下属分级基金的交易代码	006059	006060
报告期末下属分级基金的份额总额	3, 200, 430, 474. 39 份	2, 600, 986, 447. 90 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2021 年 10 月 1 日 — 2021 年 12 月 31 日)	
	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
1. 本期已实现收益	22, 424, 584. 49	18, 054, 459. 98
2. 本期利润	66, 513, 276. 46	58, 221, 298. 26
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0235	0. 0226
4. 期末基金资产净值	3, 370, 059, 641. 98	2, 735, 552, 875. 56
5. 期末基金份额净值	1. 0530	1. 0517

注: (1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 本报告所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬泓利债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2. 28%	0. 14%	0. 95%	0. 08%	1. 33%	0. 06%
过去六个月	2. 54%	0. 15%	1. 33%	0. 11%	1. 21%	0. 04%
过去一年	5. 61%	0. 16%	3. 67%	0. 11%	1. 94%	0. 05%
过去三年	19. 65%	0. 19%	14. 68%	0. 11%	4. 97%	0. 08%
自基金合同 生效起至今	20. 26%	0. 19%	14. 76%	0. 11%	5. 50%	0. 08%

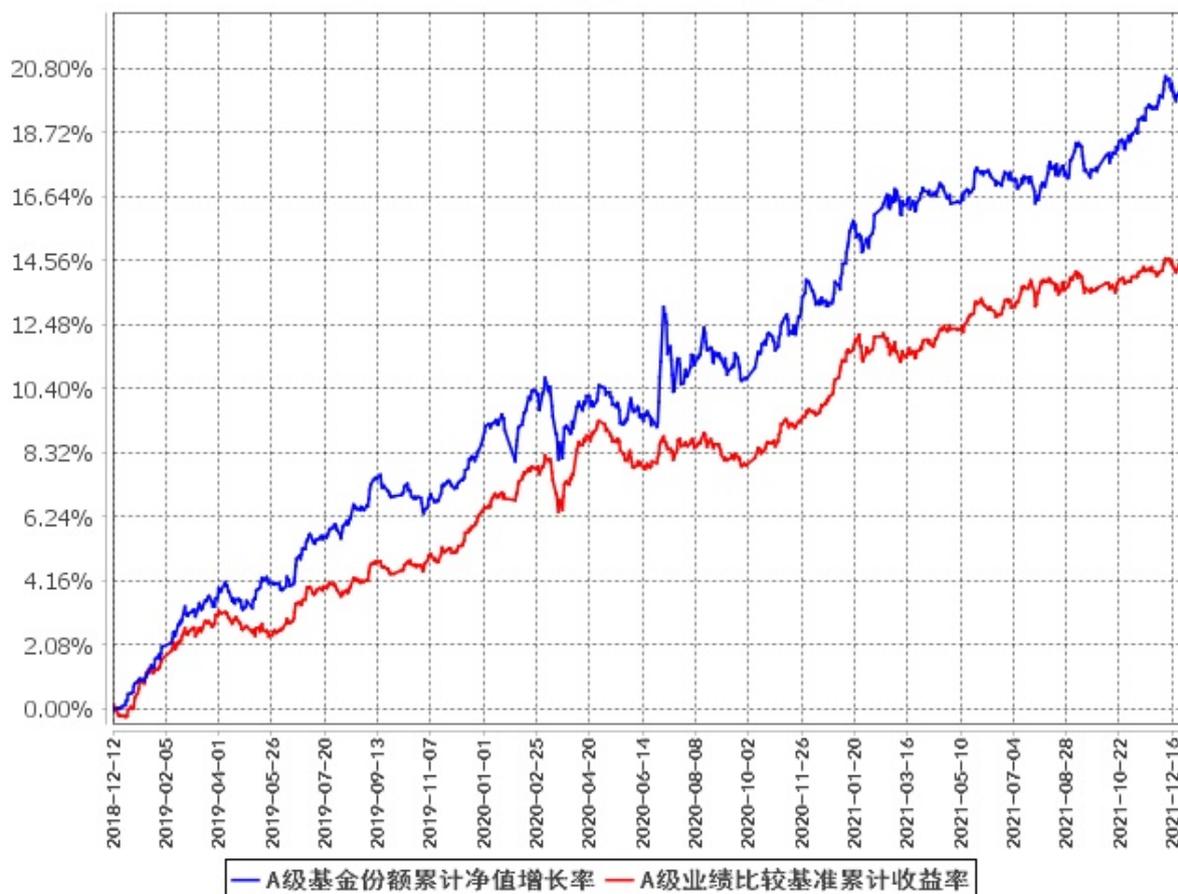
鹏扬泓利债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2. 17%	0. 14%	0. 95%	0. 08%	1. 22%	0. 06%
过去六个月	2. 33%	0. 15%	1. 33%	0. 11%	1. 00%	0. 04%

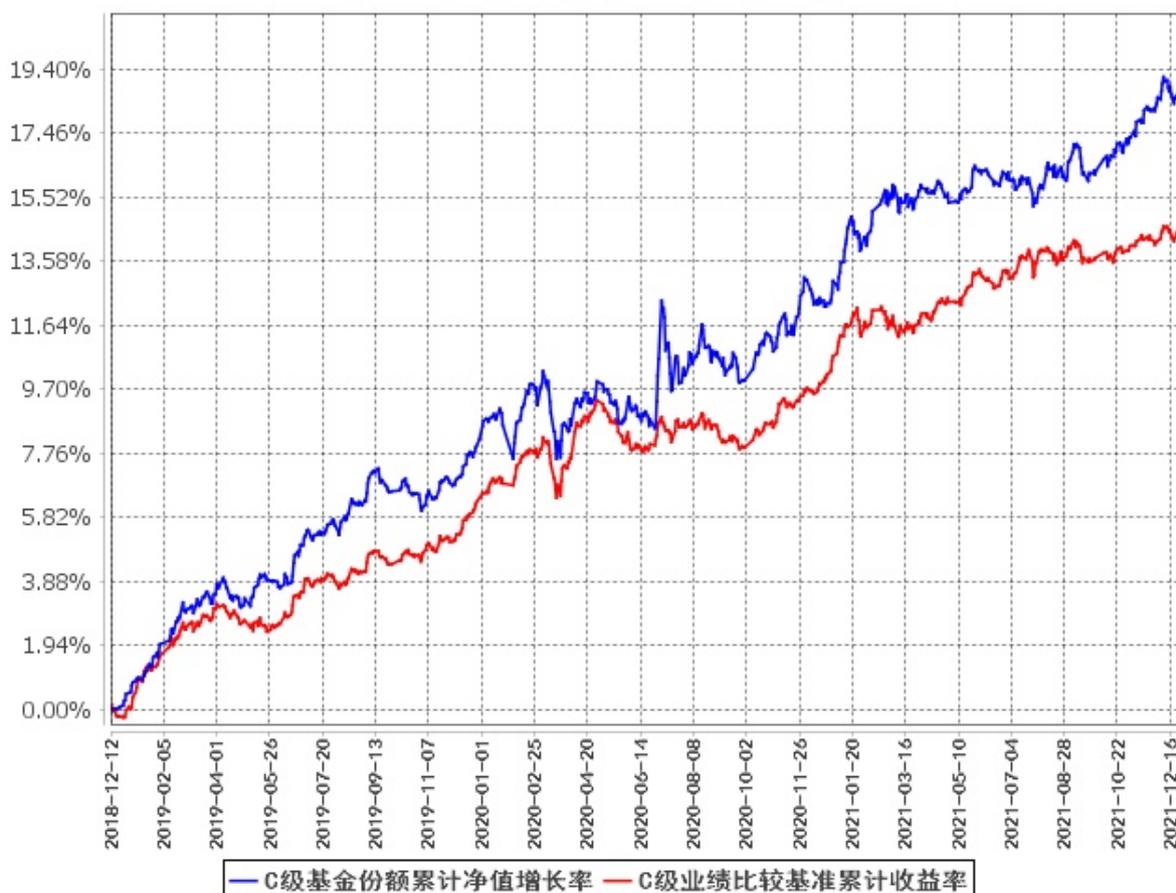
过去一年	5.19%	0.16%	3.67%	0.11%	1.52%	0.05%
过去三年	18.25%	0.19%	14.68%	0.11%	3.57%	0.08%
自基金合同生效起至今	18.82%	0.19%	14.76%	0.11%	4.06%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年12月12日至2021年12月31日)



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年12月12日至2021年12月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨爱斌	本基金基金经理, 总经理	2018年12月12日	-	22	复旦大学国际金融专业经济学硕士。曾任中国平安保险(集团)股份有限公司组合管理部副总经理, 华夏基金管理有限公司固定收益投资总监, 北京鹏扬投资管理有限公司董事长兼总经理。现任鹏扬基金管理有限公司董事、总经理。2017年6月2日至今任鹏扬汇利债券型证券投

				<p>资基金基金经理；2017 年 6 月 15 日至 2019 年 1 月 4 日任鹏扬利泽债券型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 12 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 11 日至今任鹏扬景沅六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景明一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景沃六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬景源一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 1 日至今任鹏扬聚利六个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景恒六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 7 日至今任鹏扬景惠六个月持有期混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 30 日至今任鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金基金经理。</p>
焦翠	本基金基金经理	2019 年 1 月 4 日	-	<p>8</p> <p>中国人民大学金融硕士。曾任北京鹏扬投资管理有限公司交易管理部债券交易员。现任鹏扬基金管理有限公司现金管理部基金经理。2018 年 3 月 16 日至今任鹏扬汇利债券型证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 16 日至今任鹏扬景兴混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 23 日至今任鹏扬利泽债券型证</p>

				券投资基金基金经理；2019 年 1 月 4 日至今任鹏扬泓利债券型证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 22 日至今任鹏扬淳享债券型证券投资基金基金经理；2019 年 8 月 15 日至今任鹏扬景欣混合型证券投资基金基金经理；2021 年 3 月 18 日至今任鹏扬景创混合型证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 18 日至今任鹏扬淳熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 3 日至今任鹏扬景颐混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 28 日至今任鹏扬景阳一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：(1)此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告

期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 4 季度，受新冠病毒变异冲击及全球货币财政政策边际收紧等多重因素影响，全球经济增长出现高位放缓迹象，全球制造业动能不断走弱，房屋、汽车与居家耐用品涨价对消费信心产生极大抑制，同时随着商品和服务价格上涨，工资等劳动力成本也开始提高，通货膨胀压力加剧。海外主要矛盾已经由应对疫情引起的经济、就业冲击转为应对通货膨胀，部分发达与新兴市场国家开始加息，美联储也正式宣布宽松货币政策的退出，预期在 2022 年进入紧缩和加息周期。

2021 年 3 季度以来，中国经济面临“供给冲击、需求收缩、预期转弱”三重压力。4 季度随着双碳政策全面纠偏，经济面临的供给冲击已解除，原材料价格回落后企业开始补库，工业产出活动有所恢复。但在需求方面，受财政后置和房地产去杠杆的不利影响，投资需求仍然偏弱；消费需求方面，受持续近两年的新冠疫情反复冲击，居民人均可支配收入恢复缓慢，增长乏力，明显落后于名义 GDP 增长水平。通货膨胀方面，4 季度 CPI 同比保持低位，主要是在信用收缩、需求不足的大背景下，受耐用消费品涨价压力减弱、服务业成本中的房租与农民工工资上涨乏力等因素影响；PPI 价格大幅冲高后逐步回落，主要因为随着“保供稳价”的政策出台，国内煤炭与电力供应紧张逐步缓解，叠加地产投资的快速下降，上游工业原材料等大宗商品价格高位回落。

流动性方面，为应对经济下行压力和部分房地产企业的流动性风险，央行 2021 年 12 月实施全面降准并下调一年期 LPR 利率 5bp，同时加大公开市场操作力度，总体保持流动性偏宽松局面。信用扩张方面，广义社会融资总量同比增速略有回升并有企稳迹象，主要受居民部门房屋按揭贷款改善和政府债券发行提速驱动；但反映经济内生融资需求的中长期贷款延续回落态势。

2021 年 4 季度，债券市场先抑后扬，利率水平先升后降，中债综合全价指数上涨 0.6%。10 月初受降准预期落空、宽信用预期升温以及煤炭等能源价格暴涨的影响，利率快速上行；但自 10 月中下旬开始，在高频经济数据较弱、头部民营房地产企业违约风险上升、货币政策宽松预期和降准降息等利好政策的支持下，利率再次下行回到 7 月降准后的前期低位。信用利差方面，在宽松的流动性支持下，中高等级信用利差多数被动收窄，但受房地产行业基本面不断恶化和部分财政实力较弱地区的城投债券信用风险上升影响，中长期低等级城投债券利差明显走阔。4 季度，受固收+策略产品规模大幅上升对转债市场的大规模配置资金驱动，可转债市场大幅上涨，转债估值水平进一步大幅

提升。

操作方面，本基金本报告期内债券投资保持偏低的组合久期策略和严格防范信用风险的信用策略。利率策略方面，组合随着债券市场回升减持了全部利差水平偏低的政策性银行永续债券，积极增仓有估值优势的 15 年提前还本地方政府债及 1 年期付息国债，同时通过国债期货灵活套保对冲以降低久期波动风险。信用策略方面，组合坚持高评级、高质量、高流动性的优质短期信用债券配置思路，逐步减持了部分产业投资类国有企业债券，积极参与系统重要性银行二级资本债的交易性投资，同时在一二级市场小幅增仓 3 年期公司债。杠杆策略方面，考虑到货币政策总体宽松，组合适度提高杠杆水平。可转换债券方面，考虑到组合的直接权益风险暴露较高，因此主要配置了偏防御型的大盘价值转债，而对高景气、高估值、高价格的成长转债则更愿意直接参与正股投资；同时，鉴于银行转债的债底安全边际高、银行基本面与估值水平的偏离越来越大，组合进一步通过一二级市场申购和二级市场逢低买入操作增仓大盘低价银行转债；此外，考虑到 PPI 价格见顶，组合逐步减持了周期有色转债。

2021 年 4 季度，全球股票市场震荡走高。国内股票市场 A 股面临宏观整体环境偏弱、微观基本面好坏参半局面，整体呈现震荡上涨格局，但风格与行业分化较大。从风格来看，中小盘风格跑赢大盘风格。代表大盘价值风格的上证 50 指数上涨 2.42%，沪深 300 指数上涨 1.52%；代表中小盘成长风格的创业板指数和中小板指数分别上涨 2.40%和 6.21%。从行业板块来看，市场始终保持快速轮动特征，前期热门赛道股新能源行业和医药 CXO 行业见顶回落，而受“元宇宙”等概念推动的传媒、通讯、电子等行业涨幅较大。此外，受益于上游原材料价格回落和政策支持的军工以及受益于房地产政策改善预期的家居等轻工制造行业也明显回升，而受房地产投资下滑加速冲击的房地产、银行跌幅居前，受上游大宗商品价格回落影响的钢铁、有色、化工等周期板块也明显走弱。

操作方面，本基金本报告期内权益仓位总体变化不大，年末略有提高，主要以结构调整为主。金融股方面，组合继续超配估值挤压与盈利增长严重背离的银行股，但对结构进行适度调整，大幅增仓基本面较好、业绩弹性较大的全国性股份制银行和股价弹性大、估值保护足的大型国有银行，主要减仓弹性较弱、防御性较好的国有大行。同时，组合减持基本面一直没有起色的保险股，积极增仓财富管理领域有竞争优势的龙头券商股，小幅增仓低估值存在反转机会的地产股(港股)，并通过积极的交易性投资降低组合的持仓成本。消费股方面，组合逢高清仓止盈白酒股，部分止盈获利较大的乳业龙头股和调味品个股，逢低增仓啤酒股、汽车股(港股)和低估值的其他日常消费股。科技股方面，组合逢低增仓军工电子龙头企业股、光学消费电子股及半导体材料股，高点止盈组合前期重点买入的 IGBT 重仓股和消费电子股，逢高减仓计算机股。高端制造方面，组合低位加大对有业绩、有弹性、有政策支持国防军工行业的投资，并在年底高点及时止盈卖出；战略性买入专精特新

新领域的部分高端机床、工业自动化的行业个股；积极增仓受益于绿色金融政策支持的新能源运营商股和新能源行业上游资源股及高景气的设备制造商的股票。周期股方面，组合继续低位增仓基建投资可能回升的工程机械股和造纸龙头企业股。医药股方面，组合逢高减持受损于疫情反复的零售药店股，小幅增仓大幅回调的优质 CDMO 个股。目前组合形成以低估值金融为主，消费、科技、制造、医药、周期为辅的相对分散的均衡持仓结构。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬泓利债券 A 的基金份额净值为 1.0530 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.28%；截至本报告期末鹏扬泓利债券 C 的基金份额净值为 1.0517 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.17%；同期业绩比较基准收益率为 0.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,101,574,752.41	15.35
	其中：股票	1,101,574,752.41	15.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,743,988,091.89	80.06
	其中：债券	5,743,988,091.89	80.06
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	72,900,000.00	1.02
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	152,178,395.72	2.12
8	其他资产	103,945,301.83	1.45
9	合计	7,174,586,541.85	100.00

注：本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 101,172,423.97 元，占期末基金资产净值的比例为 1.66%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	411,754,100.99	6.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,978,000.00	0.36
E	建筑业	31,615,808.00	0.52
F	批发和零售业	16,734,882.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	486,610,432.34	7.97
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	31,709,105.11	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,000,402,328.44	16.38

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	41,103,695.36	0.67
C 消费者常用品	11,652,516.96	0.19
D 能源	-	-
E 金融	20,425,021.57	0.33
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	17,180,065.28	0.28
J 公用事业	720,305.60	0.01
K 房地产	10,090,819.20	0.17
合计	101,172,423.97	1.66

注：以上行业分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	6,004,484	114,325,375.36	1.87
2	601939	建设银行	16,226,700	95,088,462.00	1.56
3	601818	光大银行	28,278,449	93,884,450.68	1.54
4	000001	平安银行	4,596,600	75,751,968.00	1.24
5	601658	邮储银行	5,987,963	30,538,611.30	0.50
6	02238	广汽集团	4,798,000	30,166,676.51	0.49
7	000776	广发证券	1,200,000	29,508,000.00	0.48
8	300054	鼎龙股份	1,066,300	25,953,742.00	0.43
9	603501	韦尔股份	75,000	23,307,750.00	0.38
10	600483	福能股份	1,350,000	21,978,000.00	0.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	430,891,400.00	7.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,053,000.00	1.66
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,060,521,000.00	17.37
5	企业短期融资券	1,631,925,000.00	26.73
6	中期票据	1,892,973,000.00	31.00
7	可转债（可交换债）	332,267,691.89	5.44
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	294,357,000.00	4.82
10	其他	-	-
11	合计	5,743,988,091.89	94.08

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	2,100,000	210,063,000.00	3.44
2	110059	浦发转债	1,876,140	198,214,191.00	3.25
3	2171290	21 河北债 61	1,500,000	152,310,000.00	2.49
4	101900888	19 鄂交投 MTN002	1,500,000	151,710,000.00	2.48
5	019649	21 国债 01	1,420,000	142,028,400.00	2.33

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。制定国债期货套期保值策略时，基金管理人通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并根据基金现券资产利率风险敞口采用流动性好、交易活跃的期货合约。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，规避利率风险以达到降低投资组合的整体风险的目的。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
T2203	T2203	-220	-221,672,000.00	-217,050.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-217,050.00
国债期货投资本期收益 (元)					138,349.51
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-217,050.00

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期内以套期保值为主要目的进行了国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型，并与现券资产进行匹配，较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其派出机构的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局或其派出机构的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,562,821.81
2	应收证券清算款	4,031,043.26
3	应收股利	-
4	应收利息	62,664,699.55
5	应收申购款	32,686,737.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	103,945,301.83

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	198,214,191.00	3.25
2	132015	18 中油 EB	61,886,157.80	1.01
3	113021	中信转债	54,310,000.00	0.89
4	128081	海亮转债	7,674,382.10	0.13
5	110064	建工转债	6,133,679.00	0.10
6	113042	上银转债	2,303,973.80	0.04
7	123107	温氏转债	688,398.00	0.01
8	132022	20 广版 EB	229,900.00	0.00
9	113530	大丰转债	98,703.60	0.00
10	110052	贵广转债	62,563.20	0.00

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
报告期期初基金份额总额	2,796,493,902.39	2,550,648,374.32
报告期期间基金总申购份额	882,175,235.23	659,398,966.03
减：报告期期间基金总赎回份额	478,238,663.23	609,060,892.45
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	3,200,430,474.39	2,600,986,447.90

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

	鹏扬泓利债券 A	鹏扬泓利债券 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	15,894,519.21	-
报告期期间买入/申购总份额	9,724,223.78	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	25,618,742.99	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.44	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	转换入	2021 年 12 月 7 日	4,673,709.80	4,999,000.00	-
2	转换入	2021 年 12 月 8 日	4,571,748.46	4,900,000.00	0.00%
3	红利再投	2021 年 12 月 22 日	478,765.52	502,799.55	0.00%
合计			9,724,223.78	10,401,799.55	

注：根据本基金招募说明书相关规定，A 类基金份额申购金额大于等于 500 万元时，按固定费用每笔 1000 元收取申购费。上述适用此标准的交易，按此规定执行。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬泓利债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬泓利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬泓利债券型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2022 年 1 月 22 日